

NYマーケットレポート(2013 年 1 月 22 日)

昨晚の外国為替市場は、日銀の金融政策決定会合で、無制限金融緩和と2%の物価上昇率目標が決定されましたが、資産買い入れが2014年からの実施となったことから、早期の緩和策が不十分との見方が広がり、アジア市場から円買いが膨らみました。ただ、NY市場ではその流れが一服し、序盤のドル円・クロス円は値を戻す動きが優勢となりました。しかし、米製造業関連や住宅関連の経済指標が、市場予想を下回る結果となったことから、リスク回避の円買い戻しが優勢となりました。その後、ドル円・クロス円は再び堅調な動きとなりましたが、欧州要人の円安牽制発言などを背景に、ドル円・クロス円は上値の重い動きが続きました。

2013/1/22 (火)

TOKYO	東京終値	東京高値	東京安値
USD/JPY	89.10	90.10	88.90
EUR/JPY	119.01	120.16	118.64
GBP/JPY	141.21	142.78	140.92
AUD/JPY	94.10	94.89	93.73
EUR/USD	1.3360	1.3374	1.3301

LONDON	LD高値	LD安値
USD/JPY	89.18	88.39
EUR/JPY	119.17	117.36
GBP/JPY	141.35	139.82
AUD/JPY	94.21	93.33
EUR/USD	1.3368	1.3268

*LD高安は東京クローズ～NYオープンまでの高安

NEW YORK	NY終値	NY高値	NY安値
USD/JPY	88.71	88.99	88.52
EUR/JPY	118.15	118.51	117.58
GBP/JPY	140.49	141.17	140.36
AUD/JPY	93.72	94.00	93.38
NZD/JPY	74.61	74.92	74.33
EUR/USD	1.3320	1.3326	1.3279
AUD/USD	1.0566	1.0569	1.0548

米主要株	終値	前日比
米ダウ平均	13712.13	+62.43
S&P500	1492.51	+6.53
NASDAQ	3143.18	+8.47
その他主要株	終値	前日比
■ トロント総合	12824.63	+30.38
■ ボルサ指数	45320.30	+96.45
■ ボベスバ指数	61692.29	-207.42

1/23 経済指標スケジュール

08:30 【豪】11月ウエストバック先行指数
 09:30 【豪】4Q消費者物価指数
 14:00 【シンガポール】12月消費者物価指数
 16:45 【仏】1月企業景況感指数
 17:00 【南ア】12月消費者物価指数
 18:30 【英】12月失業率
 18:30 【英】12月失業率推移
 19:00 【スイス】1月ZEW景況感調査
 21:00 【米】MBA住宅ローン申請指数
 23:00 【米】11月住宅価格指数
 23:00 【カナダ】12月住宅価格指数
 00:00 【カナダ】政策金利発表
 00:00 【欧】1月消費者信頼感

・世界経済フォーラム（ダボス）～27日

欧州主要株	終値	前日比
英FT100	6179.17	-1.81
仏CAC40	3741.01	-22.02
独DAX	7698.79	-52.65
ST欧州600	287.66	-0.12

コモディティ	終値	前日比
NY GOLD	1693.20	+6.20
NY 原油	96.24	+0.68

米国債利回り	本日	前日
2年債	0.24%	0.25%
3年債	0.36%	0.37%
5年債	0.75%	0.76%
7年債	1.24%	1.24%
10年債	1.84%	1.84%
30年債	3.02%	3.03%

(出所:ブルームバーグ)

NY 市場レポート

欧州市場

21:00

《 経済指標の結果 》

トルコ政策金利発表 5.50% (予想 5.50%・前回 5.50%)



(出所:ブルームバーグ)

22:00

ドル/円 88.69 ユーロ/円 118.17 ユーロ/ドル 1.3325

22:00

欧州株式市場・米株価指数先物

欧州主要株価	株価	前日比	米株価先物	株価	前日比
英 FT100	6177.94	-3.04	ダウ INDEX FUTURE	13568	-8
仏 CAC40	3752.68	-10.35	S&P500 FUTURE	1478.00	+0.90
独 DAX	7714.30	-34.56	NASDAQ FUTURE	2735.75	+2.00

(出所:ブルームバーグ)

22:20

《 要人発言 》

安倍首相

- ・「物価目標は日銀にのませたというよりも日銀が了解し」
- ・「諮問会議で軌道に乗っているかチェックしたい」
- ・「円安によって産業は競争力うんと強まり利益上げていく」
- ・「給与増までの期間をなるべく短くしたい」
- ・「為替のレベルどれぐらいいいかは言わない」
- ・「今までの円高は行き過ぎていた」

22:30

《 経済指標の結果 》

12 月シカゴ連銀全米活動指数 0.02(前回 0.27)

前回発表の 0.10 から 0.27 に修正



(出所:ブルームバーグ)

11 月カナダ小売売上高(前月比) 0.2%(予想 0.0%・前回 0.5%)

前回発表の 0.7%から 0.5%に修正

11 月カナダ小売売上高[除自動車](前月比) 0.2%(予想 0.1%・前回 0.2%)

前回発表の 0.5%から 0.2%に修正



(出所:ブルームバーグ)



(出所:ブルームバーグ)

22:40

《 要人発言 》

安倍首相

- ・「円安によって産業は競争力が強まり利益を上げていく」
- ・「金融政策の手段は日銀に任せなければいけない」
- ・「領空侵犯には国際法にのっとって対応」
- ・「中国と良好な関係維持が国益だが尖閣は譲ることできない」

23:33

米主要株価

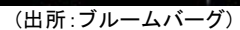
米主要株	株価	前日比
ダウ平均	13650.80	-1.13
ナスダック	3137.61	-2.91

(出所:ブルームバーグ)

0:00

《 経済指標の結果 》

1 月リッチモンド連銀製造業指数 -12(予想 5・前回 5)



《リッチモンド連銀製造業指数》

1 月 · · 12 月 · · 11 月 · · 10 月 · · 9 月 · · 8 月

景況指數...-12... 5... 9... -7... 4... -9

新規受注・・・-17・・・10・・・11・・・ -6・・・ 7・・・-20

雇用者数・・・5・・・ 3・・・ 3・・・ 5・・・5・・・ 5・・・

価格動向 1 月・12 月・11 月・10 月・9 月・8 月

仕入価格・・・2.54・・・2.01・・・1.99・・・3.21・・・1.42・・・1.32

販売価格・・・0.85・・・1.57・・・1.72・・・1.99・・・0.44・・・0.51

在庫水準

最終財..... 23... 12... 19... 15... 18...18

素材····· 23··· 24··· 21··· 23··· 17···24

《 経済指標の結果 》

12月米中古住宅販売件数 494 万件(予想 510 万件・前回 499 万件)

前回発表の 504 万件から 499 万件に修正

12月米中古住宅販売件数(前月比) -1.0%(予想 1.2%・前回 4.8%)

前回発表の 5.9%から 4.8%に修正



(出所:ブルームバーグ)

経済指標データ

《中古住宅販売》

12月・11月・10月・9月・8月

販売戸数	494	499	476	469	483
北東部	64	62	58	59	63
中西部	112	119	111	109	111
南部	195	201	189	188	192
西部	123	117	118	113	117

(万件)

0:30

《 NY 株式市場 序盤 》

序盤の株式市場は、前週末に約 5 年 1 ヶ月ぶりの高値をつけたことから、利益確定のための売りと、発表が本格化している米企業の四半期決算を期待した買いが交錯するもみ合いの展開が続いている。

《 経済指標のポイント 》

(1)トルコ中央銀行は、上限政策金利となる翌日物貸出金利は 8.75%、下限金利の翌日物借入金利を 4.75%とし、これまでの水準からそれぞれ 0.25 ポイント引き下げた。ただ、1 週間物レポ金利は 5.50%に据え置いた。市場予想では、3 金利とも据え置きとの予想がコンセンサスだった。トルコ中銀は、通貨リラの上昇につながる資本流入を抑えるため、ここ 3 ヶ月で 2 回目の利下げに踏み切った。

(2)リッチモンド連銀製造業指数は、-17 となり、昨年 7 月以来 6 ヶ月ぶりの低水準となった。また、各部門の指数も軒並み大きく低下する結果となった。新規受注は-17(前月 10)となり 8 月以来の低水準、出荷-11(前回 6)、受注残-19(前回-11)、雇用-5(前回-3)。ただ、半年先の予想は、新規受注は 18(前月 12)、出荷 18(前回 20)、受注残 0(前回 0)、雇用 0(前回 2)とやや横ばいとなっている。

(3)NAR(全米不動産業者協会)が発表した 2012 年 12 月の中古住宅販売戸数は、年率換算で前月比-1.0%の 494 万件と 3 カ月ぶりに前月水準を下回った。前年同月比は+12.8%となった。2012 年年間の販売件数は前年比+9.2%の 465 万件と、戸数ベースで 2007 年以来 5 年ぶりの高水準となった。伸び率は 2004 年以来 6 年ぶりの大きさ。

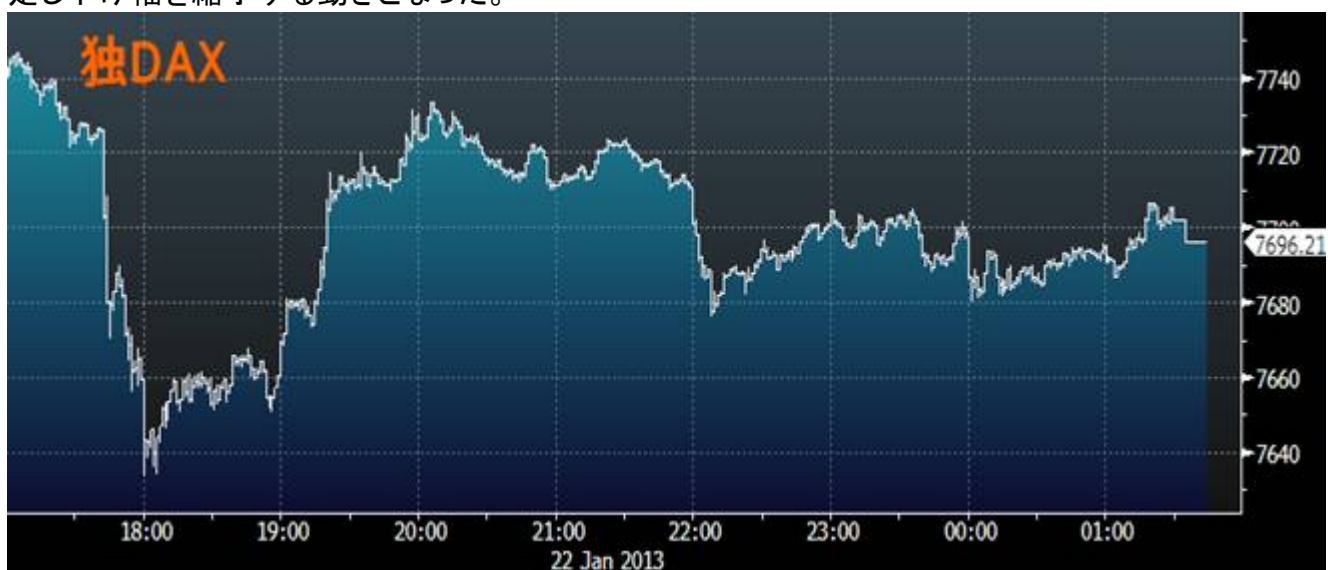
- ①市場に出て売れ残った住宅在庫は 12 月末時点で前月比-8.5%の 182 万件と、2001 年 1 月以来の低い水準となり、前年同月比では-21.6%となった。
- ②販売に対する在庫の比率は 4.4 カ月と前月から 8.3%低下し、2005 年 5 月以来の低さとなった。
- ③在庫が限られているため販売戸数も抑制されているものの、12 年は販売件数と価格がともに大きく伸びており、来年もさらに伸びると予想する声もある。

欧州主要株価	終値	前日比
英 FT100	6179.17	-1.81
仏 CAC40	3741.01	-22.02
独 DAX	7698.79	-52.65
ストック欧州 600 指数	287.66	-0.12
ユーロファースト 300 指数	1165.49	-1.04
スペイン IBEX35 指数	8632.10	-33.80
イタリア FTSE MIB 指数	17715.90	+83.91
南ア アフリカ全株指数	39912.45	-77.12

(出所:ブルームバーグ)

《欧州株式市場》

欧州株式市場は、やや新規材料に乏しく主要株価は反落となった。ただ、独 DAX は、独連銀総裁が辞任するとのうわさが流れたことから、一時急落したものの、連銀側が総裁辞任説を否定し下げ幅を縮小する動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)

2:00

米主要株価・中盤

ダウ 13667.61(+17.91)、 S&P500 1484.52(-1.46)、 ナスダック 3126.83(-7.87)

《 NY 債券市場 ・午前 》

NY 債券市場は、米連邦債務の上限について下院多数派の共和党が 5 月 19 日までの政府支出分だけ引き上げる法案の可決を目指す方針を明らかにしたことから、安全資産に対する需要が弱まり、売りが先行した。ただ、その後は、昨年 12 月の米中古住宅販売戸数が市場予想を下回ったため買い戻しが入り、もみ合いで推移した。

午前の利回りは、30 年債が 3.04% (前週末 3.03%)、10 年債が 1.85% (1.84%)、7 年債が 1.25% (1.24%)、5 年債が 0.77% (0.76%)、3 年債が 0.37% (0.37%)、2 年債が 0.25% (0.25%)。

《ここまでの欧州のポイント》

①スペイン政府は入札を実施し、3 カ月物と 6 カ月物の証券を計 28 億ユーロ (約 3300 億円) 発行した。3 カ月物の平均落札利回りは 0.441% (前回 1.195%)、応札倍率は 4.19 倍 (前回 2.92 倍)。6 カ月物は 0.888% (前回 1.609%)、応札倍率は 3.85 倍 (前回 2.57 倍)。発行高は、目標上限の 25 億ユーロを上回った。

②ドイツの ZEW (欧州経済研究センター) がまとめた 1 月の独景況感指数で、期待指数が前月の 6.9 から 31.5 に上昇するなど、予想を大きく上回る改善となり、2 年半ぶり高水準に達した。独景気が勢いを増すとの期待は高まっているようだ。

③ギリシャ財務省の発表によると、国営企業の支出を除いたベースの財政赤字は 157 億ユーロ (約 1 兆 8570 億円) と、2011 年の 228 億ユーロから減少した。速報値は 159 億ユーロ、政府目標は 163 億ユーロだった。歳出削減を進めたほか、歳入が想定されていたほど落ち込んでいなかったため、先の見積もりを上回る規模の赤字削減を達成した。

4:20

NY 金は、中心限月が前週末比 6.20 ドル高の 1 オンス = 1693.20 ドルで取引を終了した。

4:45

《 要人発言 》

キング BOE 総裁

- ・「イングランド銀は、必要に応じて追加刺激の用意」
- ・「イングランド銀の金融政策体制、見直しは理にかなう」

5:20

NY 原油は、中心限月が前週末比 0.68 ドル高の 1 バレル = 96.24 ドルで取引を終了した。

コモディティー	終 値	前日比
NY GOLD	1693.20	+6.20
NY 原油	96.24	+0.68

(出所:ブルームバーグ)

《 NY 金市場 》

NY 金は、日銀が金融政策決定会合で追加金融緩和や物価上昇率の 2% 目標導入を決めたことから、余剰資金が金市場に流入しやすくなるとの観測が広がったほか、インフレヘッジとしての金買いも支援材料となった。終値ベースでは、昨年 12 月中旬以来、約 1 カ月ぶりの高値水準となった。



(出所:ブルームバーグ)

《 NY 原油市場 》

NY原油は、米国株の上昇につれて投資家心理が強まり、買いが優勢となった。日銀が金融政策 決定会合で追加金融緩和を決めたことも、相場の支援材料となった。終値ベースでは、昨年 9 月中旬以来、約 4 ヶ月ぶりの高値水準となった。



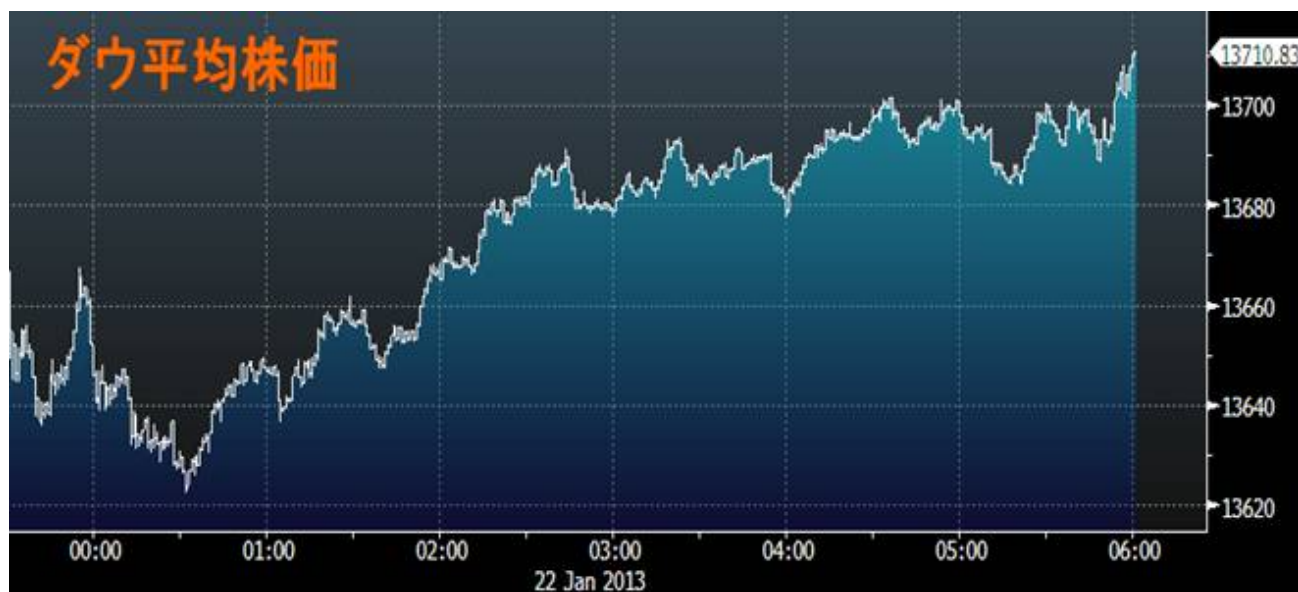
(出所:ブルームバーグ)

米主要株価	終値	前日比	高値	安値
ダウ平均株価	13712.13	+62.43	13712.13	13622.96
S&P500 種	1492.51	+6.53	1492.51	1481.16
ナスダック	3143.18	+8.47	3143.17	3121.53

(出所:ブルームバーグ)

《米株式市場》

米株式市場は、前週末に約 5 年 1 ヶ月ぶりの高値をつけたことから、主要株価は利益確定の売りが先行した。また、米製造業、住宅関連の経済指標が予想より悪化したことから、軟調な動きとなった。ただ、発表が本格化している米企業の四半期決算を期待した買いが優勢となり、その後は堅調な展開が続いた。ダウ平均株価は、序盤軟調な動きとなり、一時前週末比 26 ドル安まで下げたものの、引けにかけてはプラス圏まで上昇して引けた。



(出所:ブルームバーグ)

主要通貨	NY 終値	NY 高値	NY 安値
USD/JPY	88.71	88.99	88.52
EUR/JPY	118.15	118.51	117.58
GBP/JPY	140.49	141.17	140.36
AUD/JPY	93.72	94.00	93.38
NZD/JPY	74.61	74.92	74.33
EUR/USD	1.3320	1.3326	1.3279
AUD/USD	1.0566	1.0569	1.0548

(出所:ブルームバーグ)

《外国為替市場》

外国為替市場は、米製造業や住宅関連の経済指標がよそうより悪化したことから、ドル円・クロス円は軟調な動きとなった。しかし、その後は下落した株価がプラス圏まで値を戻したことから、円売りが優勢となり、ドル円・クロス円は午後には堅調な動きとなった。



(出所:ブルームバーグ)



(出所:ブルームバーグ)

提供: SBI リクイディティ・マーケット株式会社

お客様は、本レポートに表示されている情報をお客様自身のためにのみご利用するものとし、第三者への提供、再配信を行うこと、独自に加工すること、複製もしくは加工したものを第三者に譲渡または使用させることは出来ません。情報の内容については万全を期しておりますが、その内容を保証するものではありません。また、これらの情報によって生じたいかなる損害についても、当社および本情報提供者は一切の責任を負いません。本レポートに表示されている事項は、投資一般に関する情報の提供を目的としたものであり、勧誘を目的としたものではありません。投資にあたっての最終判断はお客様ご自身でお願いします。